

عنوان مقاله:

ارائه الگوریتم بهینه سازی علفهای هرز جهت حل مساله انتخاب سبد سرمایه گذاری

محل انتشار:

هشتمین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 6

نویسندگان:

حمیدرضا قاسمی - کارشناس ارشد مهندسی مالی

امیرعباس نجفی - استادیار دانشگاه صنعتی خواجه نصیرالدین طوسی

خلاصه مقاله:

نحوه تخصیص سرمایه دردارایی های مختلف از جمله مسائل تصمیم گیری مهم پیشروی سرمایه گذاران می باشد نخستین مساله انتخاب سبد سرمایه پرتفوی توسط مارکویتز در دهه پنجاه ارایه گردید که به مدل میانگین واریانس معروف بوده که با در نظر گرفتن تنها دو محدودیت بازده و بودجه به دنبال مینیمم سازی واریانس پرتفوی می باشد حل مدل کوادراتیک مارکویتز مرکز کارای سرمایه گذاری را به عنوان مجموعه جواب برای سرمایه گذاران به دنبال دارد در سالهای اخیر معرفی سایر محدودیت های کاربردی منجر به توسعه مدل اولیه مارکویتز گردیده اند در تحقیق پیشرو مدلی نوین جهت بهینه سازی پرتفوی ارایه گردیده است که علاوه بر مجاز شمردن فروش استقراضی برخی محدودیت های کاربردی بازار سرمایه نیز به مدل تحمیل گردیده است با توجه به پیچیدگی محاسباتی مدل پیشنهادی در اندازه های نسبتا بزرگ الگوریتم فراابتکاری بهینه سازی علفهای هرز به عنوان روش حل انتخاب گردیده است

کلمات کلیدی:

بهینه سازی پرتفوی، مدل میانگین - واریانس، برنامه ریزی کوادراتیک، بهینه سازی علفهای هرز

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/173091>

